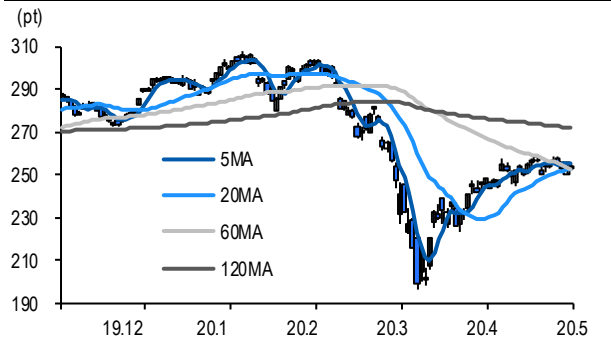


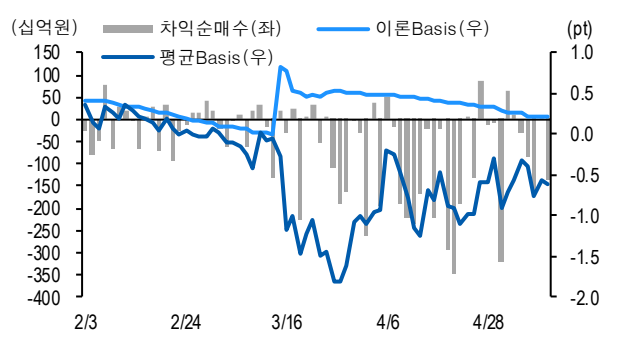


선물옵션시장 지표 2020.5.15

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	253.65	-0.86	-2.20	6,626.2	-
선물 6월물	252.35	-1.29	-3.30	22,033.5	353,238
선물 9월물	251.65	-1.29	-3.30	15.2	11,077
5월물(mini)	252.60	-1.33	-3.40	597.9	0
6월물(mini)	252.36	-1.29	-3.72	1,068.1	92,854

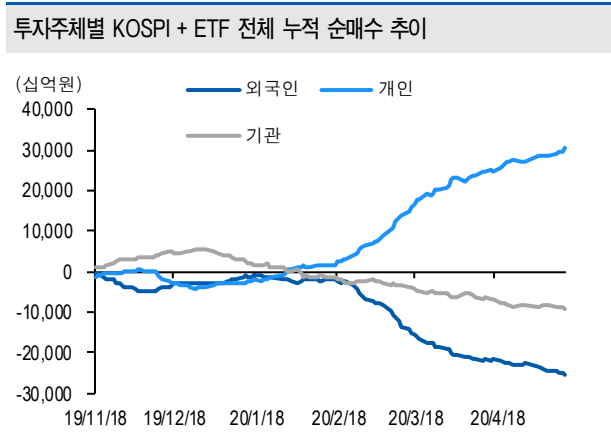


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스	0.20	-0.61	-1.30	-0.32%	
베이스(mini)	0.00	-0.15	-1.05	-0.06%	
제1스프레드(SP)	-0.18	-0.67	-0.70	-0.19%	
합성선물 베이스(ATM)	0.00	-1.10	-1.10	-0.43%	

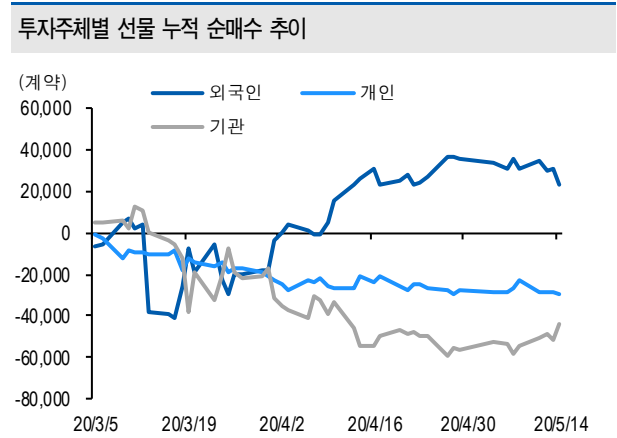


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-552.1	12.7	-539.5	-36.0	-317.4	-328.4	-155.6	1.7	-4.2	-29.5
개인	784.7	-78.3	706.4	0.0	0.0	-41.3	4.2	1.6	-1.4	6.3
기관	-237.1	67.5	-169.6	-102.3	145.4	257.7	152.4	-3.2	5.5	24.7
금융투자	-66.3	31.0	-35.3	-25.3	134.0	582.5	152.6	-0.3	4.9	12.2
투신	10.4	18.7	29.0	0.0	0.6	-398.7	-0.2	-2.1	0.7	-18.4
은행+보험+기타금융	-15.0	20.7	5.8	0.0	1.0	-10.5	0.0	-0.9	-0.1	-1.2
연기금+국가자자체	-173.2	-1.6	-174.8	-77.0	10.2	84.5	0.1	0.1	-0.1	32.0
기타법인	4.5	-1.9	2.6	0.0	-0.9	112.0	-1.1	-0.1	0.1	-1.4

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터





선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,850,672	280.8	565,456	10.3%	지수옵션 전체	3,787,371	599.4	1,324,284
Put	1,936,699	318.6	758,828	19.7%	PCR(금액기준)	1.13	VKOSPI	26.79%(+1.04%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	262.5(K+3)	0.01	-0.08	39,806	0	-34,952	27.3	Put	257.5(K+1)	5.00	2.65	11,803	0	-5,365	49.6
	260.0(K+2)	0.01	-0.28	148,995	0	-38,026	20.5		255.0(K+0)	2.50	1.34	155,643	0	-13,311	32.9
	257.5(K+1)	0.01	-0.89	446,636	0	-23,257	13.3		252.5(K-1)	0.32	-0.21	412,760	0	-16,300	14.4
	255.0(K+0)	0.05	-2.13	602,291	0	-17,700	7.9		250.0(K-2)	0.03	-0.20	494,534	0	-27,221	15.5
	252.5(K-1)	0.41	-3.64	375,068	0	-12,818	3.7		247.5(K-3)	0.01	-0.10	329,568	0	-20,234	20.5

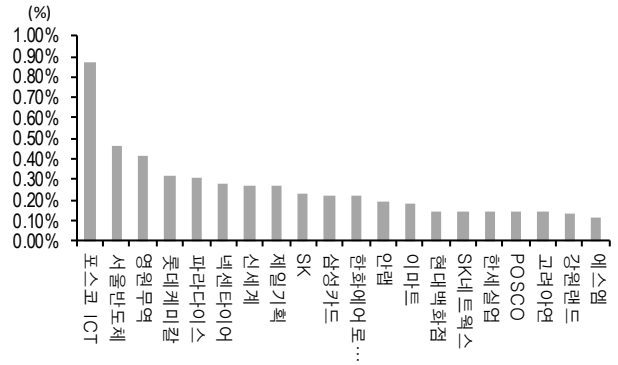
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

(계약, 십억원)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	4,254,973	2,593.2	3,750,438	-1,394,640	-62,174	37,717	28,168	-29.5	6.3	24.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
대한항공	17,950	-0.28	9.5	28.8	0	-117,668	-0.06%	-4,895	12,051	-9,087	-2,477	-4,825
카카오	225,500	4.16	91.4	28.2	0	-24,919	-0.12%	-227	-141	304	-986	840
NAVER	218,500	-0.23	39.8	21.0	0	-19,699	-0.16%	-2,066	810	1,259	-378	2,740
하이트진로	35,600	2.15	3.7	17.3	0	-11,423	-0.22%	261	52	-313	-191	-124
LG 화학	343,000	-2.70	23.2	16.9	0	-6,858	-0.02%	705	-453	-251	-437	251
대한유화	132,000	2.33	1.6	15.8	0	-2,355	-0.24%	-282	-117	755	-372	36
현대건설	32,500	-3.13	3.2	14.9	0	-17,452	0.00%	-766	711	52	636	1,542
GS 건설	23,150	-3.94	1.5	14.7	0	-22,227	-0.35%	-211	2,054	-1,843	-72	1,580
S-Oil	63,700	-3.63	7.5	14.6	0	-14,293	-0.67%	2,139	521	-2,662	-330	5,117
현대엘리베이	61,200	-1.92	1.4	13.4	0	-6,585	-0.03%	-523	38	485	-863	613

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터